

Objetivo:

Estudar métodos de análise empírica adequados ao trato de microdados em painel, para analisar problemas associados ao mercado de trabalho, desenvolvimento regional, economia industrial, educação, saúde e outros, como finanças e ciência política. O estudo dos métodos inclui o aprendizado dos comandos de programas econométricos e a leitura de artigos acadêmicos com aplicação de cada uma das metodologias estudadas.

Ementa:

Estrutura e disponibilidade de dados microeconômicos. Dados não experimentais: identificação de relações causais e avaliação. Testes de especificação e erros de medida. Endogeneidade e modelos estruturais. Dados em painel: modelos estáticos e dinâmicos. Variáveis dependentes binárias e qualitativas. Propensity Score Matching. Regressão nos quantis e regressão para misturas finitas. Métodos não paramétricos: estimação de Kernel. Modelo multi-estado e parametrização de matrizes de Markov. Aplicação nos pacotes econométricos.

1. Apresentação (1 aula)

Estrutura de dados microeconômicos.

Bases de microdados disponíveis no Brasil e no mundo.

Conceitos básicos de avaliação com dados não experimentais.

O problema da identificação de relações causais em dados não experimentais.

2. Problemas de regressões com microdados (1 aula)

Testes de especificação.

Erros de medida.

Aplicação: comando Stata `xtwest` (teste e correção de cointegração para painel de dados), `gls`.

Heterocedasticidade em modelos de regressão. Comandos Stata: `hettest`

3. Endogeneidade em microdados e Modelos estruturais (2 aulas)

Variáveis Instrumentais. Aplicação comando Stata: `ivreg`.

Método dos Momentos Generalizados. Comando Stata: `gmm`, `estat overid`, `xtinstruments`.

4. Heterogeneidade em microdados (4 aulas)

Dados em painel - modelos estáticos. Comandos Stata: `global xextra`, `regress`, `xtreg`, `fe`, `re`, `hausman`, `mle`.

Dados em painel - modelos dinâmicos. Comandos Stata: `xtabond`, `xtabond2`, `estat sargant`, `twostep`.

5. Variáveis binárias e qualitativas (2 aula)

Variáveis dependentes binárias ou qualitativas

Variáveis explicativas binárias

6. Seleção (1 aula)

Propensity Score Matching. Aplicação comando Stata: `psmatch`

7. Heterogeneidade em microdados: outros modelos (2 aulas)

Regressão nos Quantis. Comandos Stata: pgreg, matrix bslopevector, graph (quantiles)

Regressão para misturas finitas. Comandos Stata: fmm, graph (misturas finitas)

Método auxiliar: Estimação de Kernel. Aplicação de comandos Stata: kdensity

8. Modelos multi-estado (2 aulas)

Modelo de Markov. Aplicação de comandos R: msm, qmatrix.msm, pmatrix.msm

Parametrização de mudança de regime. Aplicação de comandos R: msm covariates, sojourn.

Métodos auxiliares: a) Cluster. Aplicação comando Stata: cluster k means. b) Misturas finitas.

Bibliografia

ABADIE, A., IMBENS, G. Large Sample Properties of Matching Estimators for Average Treatment Effects, *Econometrica*, 74(1), 235–267, 2006.

ARELLANO, M. *Panel Data Econometrics*. Oxford: Oxford University Press, 2003.

BLUNDELL, R., COSTA DIAS, M Alternative Approaches to Evaluation in Empirical Microeconomics, *Portuguese Economic Journal*, 1, 91–115, 2002.

CAMERON, C., TRIVEDI, P.K. *Microeconometrics: methods and applications*. Cambridge: CUP, 2005.

GREENE, W. *Econometric Analysis*, 4rd ed. New York: Macmillan, 2000.

HECKMAN, J., ICHIMURA, H., TODD, P. Matching as an Econometric Evaluation Estimator,” *Review of Economic Studies*, 65(2), 261–294, 1998.

KOENKER, R. *Quantile Regression*. Oxford: University Press, 2005.

PERSYN, E.; WESTERLUND, J. *Error-correction-based cointegration tests for panel data*, Stata Press, 2008.

WOOLDRIDGE, J. *The Econometrics of Cross Section and Panel Data*. MIT Press, 2000.